

诺安保本混合型证券投资基金

[2012]第四季度报告

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人和银行份额有限公司根据本基金合同规定，于2013年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容，确认复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金概况

基金简称:诺安保本混合

交易代码:320015

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2011年5月13日

报告期末基金份额总额:1,758,873,472.29份

本基金主要通过投资组合保险技术运作，在确保保本周期到期时本金安全的基础上，通过安全资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理，力争实现基金资产的稳健增长。

本基金通过固定比例投资组合保险策略（CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance）策略和相对不变的投资组合保险策略（Constant Proportion Investment Strategy）策略。

本基金每年保本周期内，动态调整资产配置比例，开发的保本模型进行动态仓位调整，确保投资者的收益资金的安全性。同时，本基金通过积极稳健的收益资产投资策略，竭力为基金资产提供更高的回报。

本基金的投资风格由四部分组成：股票投资策略、债券投资策略、股票投资策略、权证投资策略。

本基金本周期是本基金合同生效日起三年，其流动性与银行三年定期存款的流动性大致相当，因此本基金的业绩比较基准为：与保本周期期限的三年期银行定期存款税后收益率持平。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为各方所接受的业绩评价标准，本基金管理人可以本基金的业绩评价标准作为评价标准，本基金将根据中国证监会公告后变更本基金的业绩比较基准，并报中国证监会备案后变更本基金的业绩比较基准并即时公告。

本基金是一只保本混合型基金，在证券投资基金中属于低风险品种。

基金管理人:诺安基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

基金保证人:中国投资担保有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日 - 2012年12月31日)

1.本期已实现收益 11,301,061.93

2.本期利润 12,899,713.23

3.期初平均基金份额总额 0.0970

4.期末基金份额净值 1,874,192,748.74

5.期末可供分配基金份额利润 1.066

注:①上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.76% 0.04% 1.09% 0.01% -0.33% 0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.76% 0.04% 1.09% 0.01% -0.33% 0.03%

注:①本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

②本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

③本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

④本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

⑤本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

⑥本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

⑦本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

⑧本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

⑨本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

⑩本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

⑪本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

⑫本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

⑬本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

⑭本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

⑮本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

⑯本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

⑰本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

⑱本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

⑲本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

⑳本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

㉑本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

㉒本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

㉓本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

㉔本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

㉕本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

㉖本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

㉗本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

㉘本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

㉙本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

㉚本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

㉛本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

㉜本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

㉝本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

㉞本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

㉟本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。

㉟本基金的业绩报酬率为基金合同规定的业绩报酬率。